

# Central Daily Market Report

2020年12月7日(月)  
セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位：億円	2020年12月7日		2020年12月8日		2020年12月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,200		▲ 2,000	
財政	▲ 3,000		13,800		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 3,600		12,600		▲ 28,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,600		5,900			
CP等買入	6,000	▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 400				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			100			
国債補完供給	▲ 300	300		300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	7,500		18,600		▲ 28,000	
当座預金残高	4,781,400		4,800,000		4,772,000	
準備預金残高	4,191,400					
積み終了先	4,191,400		12月8日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,191,400		積数		100	
非準備預金先	590,000		1日平均		0	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,459,500	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	73.33%		

## ●2020年12月7日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.055~▲0.018%の出合い。週末要因が剥落したものの、調達ニーズは強く概ね横ばい圏の取引となった。一巡後は▲0.075~▲0.018%の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は月内物の引き合いが散見された程度であった。

### <レポ市場>

GC T/N(12/8-12/9)は、▲0.080~▲0.075%程度での出合い。SCはローラーオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では2Y410~419、5Y136~145、10Y345~360、20Y167~174、30Y59~68、40Y10~13等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

本日は動意なく閑散な中、3M物が▲0.087~▲0.085%、1Y物が▲0.138%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は化学業態においてまとまった発行が実施された。償還総額330億円程度に対して、発行総額は600億円程度と発行超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/12/7	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.077	0.020	0.000	26,547.44	▲ 203.80	104.20-21	104.12-14
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.081						
2W							-	▲ 0.084						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.086	▲ 0.106						
6M							▲ 0.097	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.154						
									日付	11/30	12/1	12/2	12/3	12/4
									日銀当預残	4,868,000	4,838,500	4,766,300	4,783,400	4,773,900
									準備預金残	4,287,900	4,265,100	4,197,600	4,201,500	4,186,700
									マネタリーベース	6,059,200	6,030,200	5,959,200	5,978,300	5,970,000
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.030%	▲0.029%	▲0.030%	▲0.030%
									コール市場残高	119,713	120,051	123,579	132,036	147,259
									うち無担	100,290	99,557	102,258	111,523	126,756
									うちO/N	60,852	60,849	63,935	70,650	85,863
									うち有担	19,423	20,494	21,321	20,513	20,503

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2020/12/8			13,882	5,006	▲0.004		▲0.002	42.7
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/12/8			1,277	304	0.005		0.006	15.8
国債買入(変動利付債)	500	2020/12/8			682	500	▲0.390		▲0.422	20.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/12/7	2020/12/8	▲0.350	159	159		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/7	2020/12/8	▲0.350	87	87		▲0.350	▲0.350	
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	3,000	2020/12/10			4,538	3,000	▲0.033		▲0.018	56.8

## ●2020年12月8日の予定

*7-9月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率+21.5%)	*ユーロ圏7-9月期のGDP確報値	*5年利付国債入札(25,000億円、12/9発行)
*10月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+2.5%)		
*10月の毎月勤労統計調査速報		
*10月の国際収支		
*11月の景気ウォッチャー調査		

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入